

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menganalisis pengaruh dari faktor-faktor fundamental (likuiditas, solvabilitas dan profitabilitas) secara simultan dan untuk menganalisis pengaruh dari faktor-faktor fundamental (likuiditas, solvabilitas dan profitabilitas) secara parsial terhadap *return* saham. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2007 sampai 2011. Teknik pengambilan sampel menggunakan metode *purposive sampling*. Jenis data dalam penelitian ini merupakan data sekunder yang diperoleh dari ICMD (*Indonesian Capital Market Directory*). Teknik analisis data menggunakan analisis regresi linier berganda. Hasil penelitian menunjukkan bahwa, pertama, faktor-faktor fundamental (likuiditas, solvabilitas dan profitabilitas) secara simultan berpengaruh terhadap *return* saham. Kedua, faktor-faktor fundamental likuiditas dan profitabilitas tidak berpengaruh terhadap *return* saham sedangkan solvabilitas berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata kunci : *Return* Saham, Likuiditas, Solvabilitas, Profitabilitas